

# Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	595.396,28	0,07%	776	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA F...	D+0	15/05/2025	9.255.733,08	1,04%	193	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRDESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA...	D+0	15/08/2026	84.577.907,94	9,53%	41	16,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	6.494.874,47	0,73%	34	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...		Não há	183.527,10	0,02%	21	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUND...	D+0	17/08/2026	326.780.988,41	36,82%	205	15,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	810.170,06	0,09%	731	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.423.224,16	0,16%	806	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	355.296,98	0,04%	895	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.502.354,42	0,28%	266	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.697.565,69	0,64%	727	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/05/2025	23.418.712,12	2,64%	8	56,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	396.087,98	0,04%	198	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.295.297,60	0,26%	22	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA NTN-B 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0	16/08/2026	10.004.411,21	1,13%	7	31,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REF...	D+0	Não há	894.550,38	0,10%	132	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.523.773,79	1,86%	59	6,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	114.694.270,18	12,92%	112	10,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.463.015,85	1,18%	91	2,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
SANTANDER NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	D+1 du	15/05/2025	100.380.645,00	11,31%	2	85,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b

**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)**

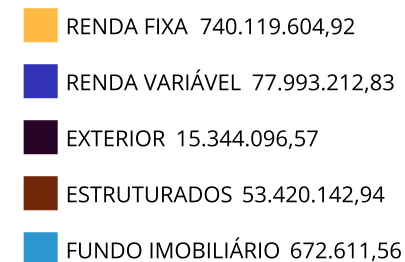
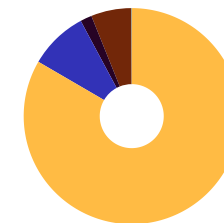
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.349.360,43	0,15%	1.040	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.669.531,64	0,41%	89	0,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	2.589.437,43	0,29%	1.441	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	443.462,33	0,05%	531	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	4.649.582,86	0,52%	370	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	511.049,36	0,06%	1.059	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.971.620,23	0,33%	211	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	163.404,15	0,02%	73	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	6.024.353,79	0,68%	1.408	0,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	13.666.535,85	1,54%	20.875	0,97%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	11.391.464,02	1,28%	16.060	0,99%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.056.541,05	0,23%	846	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.179.538,24	0,36%	198	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	159.078,99	0,02%	78	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	114.266,22	0,01%	81	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.823.085,12	0,21%	5.527	1,81%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.097.207,42	0,46%	2.256	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.300.236,84	0,48%	1.930	2,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.196.453,04	1,60%	16.187	1,50%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	8.075.619,42	0,91%	14.192	1,37%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.642.194,20	0,19%	2.759	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.781.894,68	0,43%	107	2,50%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FI...	D+3 du	Não há	4.148.147,88	0,47%	2.440	7,60%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.360.949,86	0,60%	27	2,36%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	15.344.096,57	1,73%	4.896	7,38%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	8.515.664,46	0,96%	7.888	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	18.049.018,07	2,03%	597	1,31%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	26.855.460,41	3,03%	108	2,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	672.611,56	0,08%		0,27%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>887.549.668,82</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>584.403,53</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>888.134.072,35</b>				

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2024)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	355.019.867,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	717.747.802,70	80,87%	15,00%	73,00%	90,00%	81.046.899,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	70,00%	16.347.448,43	1,84%	2,00%	9,00%	60,00%	516.182.352,86
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	177.509.933,76
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	10,00%	6.024.353,79	0,68%	0,00%	1,00%	5,00%	38.353.129,65
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>740.119.604,92</b>	<b>83,39%</b>	<b>17,00%</b>	<b>87,00%</b>	<b>215,00%</b>	



**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

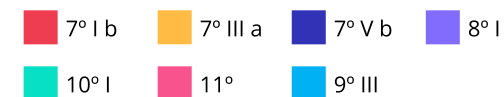
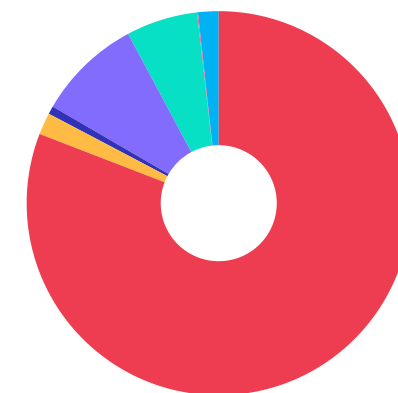


**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	77.993.212,83	8,79%	0,00%	9,90%	30,00%	188.271.687,82
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	53.420.142,94	6,02%	0,00%	2,00%	10,00%	35.334.823,94
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	8.875.496,69
Artigo 11º	10,00%	672.611,56	0,08%	0,00%	0,10%	1,00%	8.202.885,13
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>40,00%</b>	<b>132.085.967,33</b>	<b>14,88%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>42,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	88.754.966,88
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.344.096,57	1,73%	0,00%	1,00%	10,00%	73.410.870,31
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>15.344.096,57</b>	<b>1,73%</b>	<b>0,00%</b>	<b>1,00%</b>	<b>20,00%</b>	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	88.754.966,88



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	717.747.802,70	80,87	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	16.347.448,43	1,84	2,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	6.024.353,79	0,68	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	77.993.212,83	8,79	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	15.344.096,57	1,73	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	53.420.142,94	6,02	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 11º	672.611,56	0,08	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	398.897.944,54	44,94	1,96
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	251.570.802,56	28,34	0,05
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	87.610.807,70	9,87	1,25
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	57.371.318,89	6,46	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	45.473.808,48	5,12	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.258.489,66	4,09	-
ITAÚ UNIBANCO	6.024.353,79	0,68	0,00
BANCO BRADESCO	3.669.531,64	0,41	0,00
ZION INVEST	672.611,56	0,08	-

**Artigo 20º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,41%	6,27%	1,80%	4,09%	9,45%	20,22%	-	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO...	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,84%	-	2,30%	-	-	-	0,49%	-
SAFRA NTN-B 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	4,32%	1,52%	3,11%	7,68%	20,09%	1,34%	1,88%
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,49%	6,95%	2,05%	4,58%	10,49%	22,52%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,13%	1,42%	-0,48%	2,24%	4,66%	9,68%	4,59%	4,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,77%	-1,21%	1,69%	-0,25%	3,11%	18,58%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	-1,30%	1,65%	-0,34%	3,06%	17,99%	3,76%	6,40%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,59%	4,88%	1,91%	3,56%	8,14%	21,08%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	4,74%	1,86%	3,45%	7,92%	20,66%	1,09%	1,78%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,57%	4,71%	1,85%	3,44%	7,88%	20,53%	1,09%	1,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	4,66%	1,80%	3,38%	7,84%	20,50%	1,11%	1,79%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,52%	1,49%	1,63%	1,40%	5,32%	19,81%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,70%	1,46%	1,68%	1,36%	5,23%	19,40%	2,46%	4,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	1,33%	1,56%	1,26%	5,08%	19,27%	2,44%	4,09%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,70%	0,71%	1,52%	0,81%	4,53%	19,26%	2,35%	4,35%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,50%	1,31%	1,56%	1,26%	5,04%	19,20%	2,44%	4,10%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,48%	1,13%	1,49%	1,07%	4,66%	18,88%	2,48%	4,16%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BRDESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	7,33%	2,70%	5,39%	11,61%	26,97%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,78%	6,37%	2,32%	4,69%	10,11%	23,11%	0,00%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,57%	8,35%	2,46%	6,62%	12,74%	24,65%	1,41%	1,52%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	7,75%	2,79%	5,69%	12,44%	28,47%	0,04%	0,15%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	7,01%	2,57%	5,16%	11,04%	25,93%	0,01%	0,05%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92%	7,71%	2,77%	5,61%	12,12%	27,88%	0,04%	0,10%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,69%	5,65%	2,05%	4,15%	8,98%	21,15%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79%	6,39%	2,33%	4,70%	10,11%	23,82%	0,01%	0,05%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,68%	4,05%	1,82%	2,80%	7,52%	22,31%	0,64%	1,36%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,71%	3,53%	1,39%	2,47%	7,38%	21,12%	0,69%	2,56%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,60%	3,70%	1,80%	2,75%	8,02%	21,19%	0,83%	1,76%
SANTANDER NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,18%	-3,85%	-1,17%	-1,53%	-1,04%	-	5,50%	5,85%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4,51%	-2,60%	8,56%	0,89%	7,56%	8,51%	6,53%	14,00%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	6,79%	-0,51%	10,76%	1,70%	10,94%	12,85%	7,56%	15,69%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	-0,11%	-17,53%	-2,92%	-4,68%	0,25%	4,79%	8,73%	21,12%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	6,90%	1,01%	11,26%	3,30%	13,74%	14,85%	6,20%	14,38%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6,27%	0,88%	11,55%	5,02%	16,35%	21,94%	5,43%	13,11%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	8,06%	22,97%	10,50%	16,89%	41,96%	74,49%	17,47%	28,88%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC AÇÕES	5,69%	-1,80%	11,43%	1,76%	10,38%	6,59%	6,85%	15,95%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,06%	-4,63%	9,00%	-1,19%	7,75%	17,01%	7,72%	15,02%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	6,07%	-7,69%	8,69%	0,85%	-0,87%	-17,14%	9,26%	20,75%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6,47%	1,19%	11,25%	5,22%	17,06%	23,58%	5,44%	12,80%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	6,51%	3,14%	11,66%	6,63%	19,46%	24,91%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5,90%	1,79%	11,64%	5,34%	16,83%	18,86%	5,86%	12,96%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	6,69%	5,00%	10,87%	7,85%	21,94%	34,91%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,45%	4,12%	10,36%	7,10%	20,29%	31,42%	5,12%	11,58%

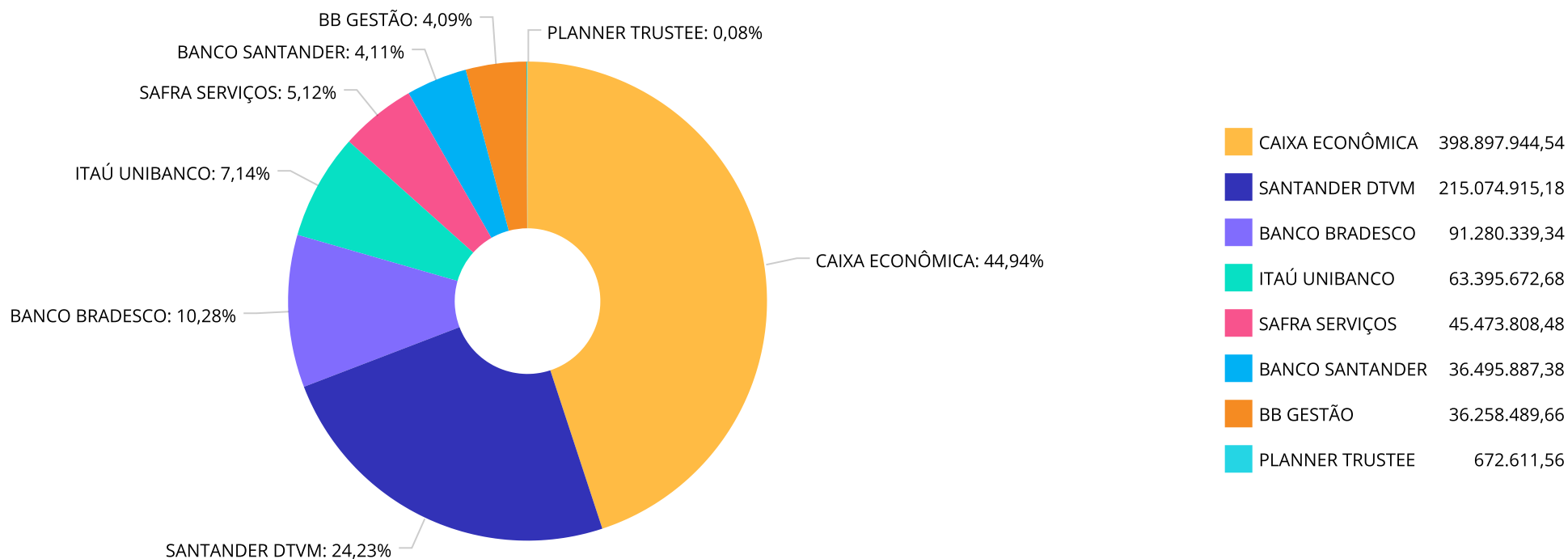
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IFIX (Benchmark)</b>	0,86%	2,48%	0,33%	1,00%	5,63%	14,02%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-4,65%	19,71%	-11,83%	-11,35%	-13,68%	-59,80%	13,74%	42,23%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,02%	2,85%	0,57%	1,58%	4,24%	9,04%	-	-
SANTANDER NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	2,29%	33,98%	14,52%	24,30%	39,63%	48,51%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,48%	21,25%	7,95%	12,81%	30,89%	61,90%	9,25%	12,29%
<b>S&amp;P 500 (Moeda Original) (Benchmark)</b>	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,49%	21,30%	8,02%	12,90%	30,96%	61,90%	9,24%	12,28%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2,43%	20,80%	7,78%	12,51%	30,45%	60,63%	9,20%	12,22%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,74%	19,99%	7,29%	12,12%	28,27%	52,77%	9,37%	12,31%

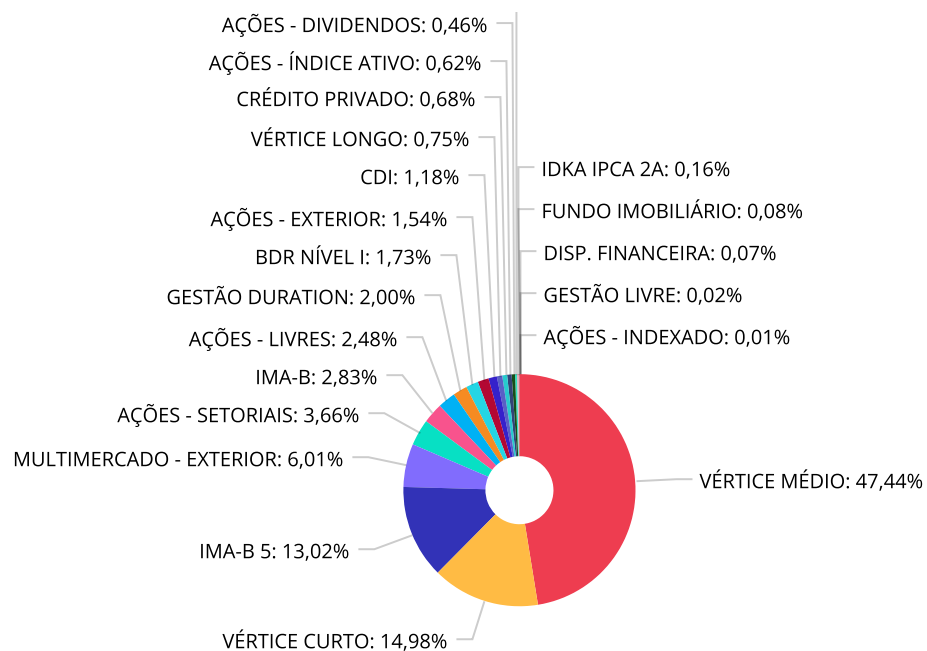
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,52%	34,84%	12,56%	23,74%	41,84%	49,87%	8,52%	12,434%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2024)



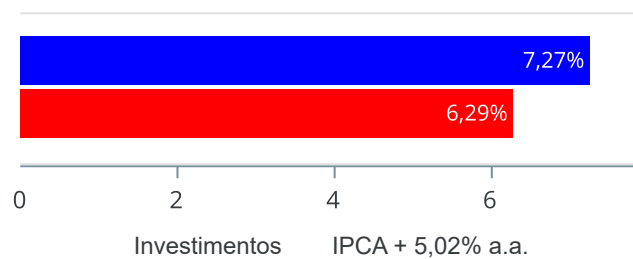
■ VÉRTICE MÉDIO	421.363.307,56	■ VÉRTICE CURTO	133.055.090,20	■ IMA-B 5	115.644.963,44	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	53.420.142,94
■ AÇÕES - SETORIAIS	32.543.542,30	■ IMA-B	25.097.031,01	■ AÇÕES - LIVRES	22.051.632,19	■ GESTÃO DURATION	17.730.031,83
■ BDR NÍVEL I	15.344.096,57	■ AÇÕES - EXTERIOR	13.666.535,85	■ CDI	10.437.442,79	■ VÉRTICE LONGO	6.678.401,57
■ CRÉDITO PRIVADO	6.024.353,79	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.520.028,85	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	4.097.207,42	■ IMA-B 5+	2.502.354,42
■ IDKA IPCA 2A	1.423.224,16	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	672.611,56	■ DISP. FINANCEIRA	584.403,53	■ GESTÃO LIVRE	163.404,15
■ AÇÕES - INDEXADO	114.266,22						



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024**

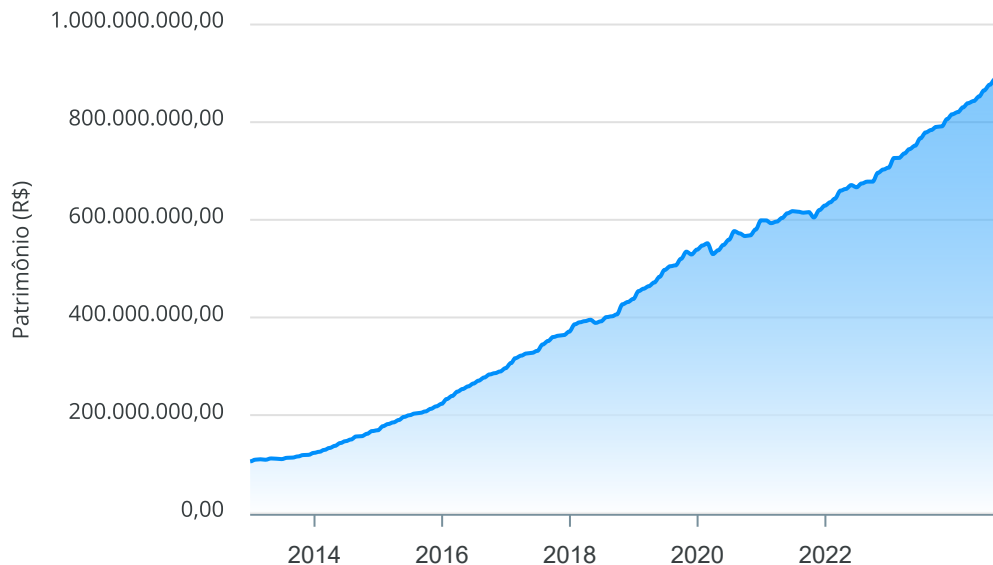
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	815.459.060,46	5.843.434,05	6.667.030,67	820.025.866,71	5.390.402,87	5.390.402,87	0,66%	0,66%	0,85%	0,85%	77,74%	1,25%
Fevereiro	820.025.866,71	27.096.214,82	25.027.641,67	829.671.554,41	7.577.114,55	12.967.517,42	0,92%	1,59%	1,20%	2,06%	76,99%	3,15%
Março	829.671.554,41	12.201.692,97	10.191.560,82	838.166.939,56	6.485.253,00	19.452.770,42	0,78%	2,38%	0,55%	2,63%	90,70%	1,16%
Abril	838.166.939,56	28.164.040,91	26.461.333,75	842.643.986,59	2.774.339,87	22.227.110,29	0,33%	2,72%	0,81%	3,46%	78,67%	1,37%
Mai	842.643.986,59	39.303.413,95	37.644.011,57	851.980.727,53	7.677.338,56	29.904.448,85	0,91%	3,65%	0,87%	4,36%	83,84%	1,48%
Junho	851.980.727,53	11.366.306,84	9.634.964,41	864.376.435,76	10.664.365,80	40.568.814,65	1,25%	4,95%	0,60%	4,98%	99,28%	1,36%
Julho	864.376.435,76	11.734.055,28	9.761.378,21	876.082.761,75	9.733.648,92	50.302.463,57	1,12%	6,13%	0,83%	5,86%	104,65%	1,46%
Agosto	876.082.761,75	564.114.560,46	562.108.391,59	887.549.668,82	9.460.738,20	59.763.201,77	1,08%	7,27%	0,41%	6,29%	115,64%	4,67%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



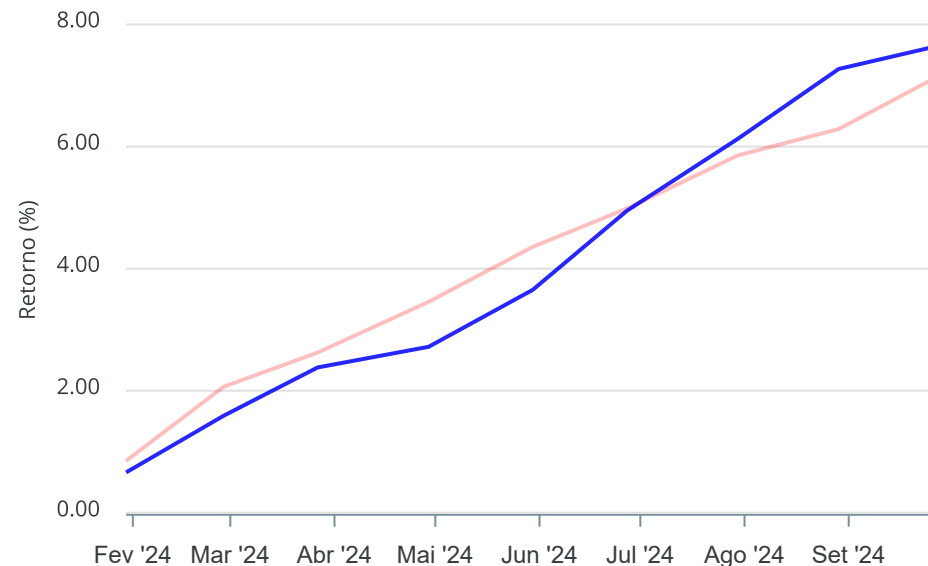
**Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores**

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos      Meta de Rentabilidade     CDI     IMA-B
- IMA-B 5     IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1
- IRF-M 1+     Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV
- Investimentos      Meta de Rentabilidade     CDI     IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1     IRF-M 1+
- Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.968.508,69	0,00	0,00	6.024.353,79	55.845,10	0,94%	0,94%	0,04%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	439.443,07	0,00	0,00	443.462,33	4.019,26	0,91%	0,91%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	506.576,93	0,00	0,00	511.049,36	4.472,43	0,88%	0,88%	0,02%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFER...	886.852,19	0,00	0,00	894.550,38	7.698,19	0,87%	0,87%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF...	9.178.392,32	0,00	0,00	9.255.733,08	77.340,76	0,84%	0,84%	0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.483.478,77	0,00	0,00	2.502.354,42	18.875,65	0,76%	0,76%	3,76%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.636.114,87	0,00	189.663,80	6.494.874,47	48.423,40	0,73%	-2,13%	4,59%
CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	187.624,66	0,00	5.438,31	183.527,10	1.340,75	0,71%	-2,18%	5,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	393.315,61	0,00	0,00	396.087,98	2.772,37	0,70%	0,70%	0,69%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.950.914,16	0,00	0,00	2.971.620,23	20.706,07	0,70%	0,70%	2,46%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.279.434,81	0,00	0,00	2.295.297,60	15.862,79	0,70%	0,70%	2,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	804.724,10	0,00	0,00	810.170,06	5.445,96	0,68%	0,68%	0,64%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	16.426.028,78	0,00	0,00	16.523.773,79	97.745,01	0,60%	0,60%	0,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.414.856,66	0,00	0,00	1.423.224,16	8.367,50	0,59%	0,59%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	353.245,94	0,00	0,00	355.296,98	2.051,04	0,58%	0,58%	1,09%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	114.039.128,88	0,00	0,00	114.694.270,18	655.141,30	0,57%	0,57%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	162.481,13	0,00	0,00	163.404,15	923,02	0,57%	0,57%	1,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	163.440.351,85	0,00	164.326.384,36	0,00	886.032,51	0,54%	0,93%	0,08%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	324.594.641,05	0,00	326.348.439,51	0,00	1.753.798,46	0,54%	-	-
BRDESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA	34.299.004,62	0,00	34.480.420,98	0,00	181.416,36	0,53%	-	-

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	592.322,50	0,00	0,00	595.396,28	3.073,78	0,52%	0,52%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.669.248,92	0,00	0,00	5.697.565,69	28.316,77	0,50%	0,50%	2,44%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.411.223,18	0,00	0,00	10.463.015,85	51.792,67	0,50%	0,50%	2,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	8.910.138,25	5.633.893,15	9.966.034,77	4.649.582,86	71.586,23	0,49%	0,78%	0,00%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.652.000,32	0,00	0,00	3.669.531,64	17.531,32	0,48%	0,48%	2,48%
ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	23.325.428,60	0,00	23.418.712,12	93.283,52	0,40%	-	-
SANTANDER NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	100.000.000,00	0,00	100.380.645,00	380.645,00	0,38%	-	-
BRASESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.413.961,62	3.000.000,00	3.848.813,00	2.589.437,43	24.288,81	0,38%	0,69%	0,01%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO ...	0,00	326.348.433,37	0,00	326.780.988,41	432.555,04	0,13%	-	-
BRASESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA F...	0,00	84.480.420,98	0,00	84.577.907,94	97.486,96	0,12%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.694,91	11.326.384,36	10.000.000,00	1.349.360,43	8.281,16	0,07%	0,79%	0,01%
SAFRA NTN-B 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.004.411,21	4.411,21	0,04%	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	13.254.174,48	0,00	12.943.196,86	0,00	-310.977,62	-2,35%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>733.362.883,27</b>	<b>564.114.560,46</b>	<b>562.108.391,59</b>	<b>740.119.604,92</b>	<b>4.750.552,78</b>	<b>0,65%</b>		<b>1,28%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.902.562,62	0,00	0,00	3.179.538,24	276.975,62	9,54%	9,54%	7,33%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	13.138.150,15	0,00	0,00	14.196.453,04	1.058.302,89	8,06%	8,06%	17,47%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	3.537.724,51	0,00	0,00	3.781.894,68	244.170,17	6,90%	6,90%	6,20%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.537.804,89	0,00	0,00	1.642.194,20	104.389,31	6,79%	6,79%	7,56%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	107.320,85	0,00	0,00	114.266,22	6.945,37	6,47%	6,47%	5,44%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.849.064,22	0,00	0,00	4.097.207,42	248.143,20	6,45%	6,45%	5,12%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.044.885,70	0,00	0,00	5.360.949,86	316.064,16	6,27%	6,27%	5,43%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.718.842,89	0,00	0,00	1.823.085,12	104.242,23	6,06%	6,06%	9,26%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	150.215,38	0,00	0,00	159.078,99	8.863,61	5,90%	5,90%	5,86%
SANTANDER ETHICAL SUSTENTABILIDADE SPECIAL IS FIC ...	3.924.740,68	0,00	0,00	4.148.147,88	223.407,20	5,69%	5,69%	6,85%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	10.882.304,16	0,00	0,00	11.391.464,02	509.159,86	4,68%	4,68%	5,93%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.967.734,74	0,00	0,00	2.056.541,05	88.806,31	4,51%	4,51%	6,53%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4.172.378,38	0,00	0,00	4.300.236,84	127.858,46	3,06%	3,06%	7,72%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	17.611.379,18	0,00	0,00	18.049.018,07	437.638,89	2,48%	2,48%	9,24%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.309.308,87	0,00	0,00	8.515.664,46	206.355,59	2,48%	2,48%	9,25%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	26.217.732,23	0,00	0,00	26.855.460,41	637.728,18	2,43%	2,43%	9,20%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	13.432.672,66	0,00	0,00	13.666.535,85	233.863,19	1,74%	1,74%	9,37%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	8.084.633,92	0,00	0,00	8.075.619,42	-9.014,50	-0,11%	-0,11%	8,73%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	705.421,88	0,00	0,00	672.611,56	-32.810,32	-4,65%	-4,65%	13,74%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>127.294.877,91</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>132.085.967,33</b>	<b>4.791.089,42</b>	<b>3,76%</b>		<b>9,23%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Agosto / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	15.425.000,57	0,00	0,00	15.344.096,57	-80.904,00	-0,52%	-0,52%	8,52%
<b>Total Exterior</b>	<b>15.425.000,57</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15.344.096,57</b>	<b>-80.904,00</b>	<b>-0,52%</b>		<b>8,52%</b>

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.





